

There's no certitude, only opportunities.

Le **PDF de cette conférence** sera disponible sur le site Mogalef-Trading.com
Les **modèles et indicateurs** sont disponibles dans le forum Mogalef.

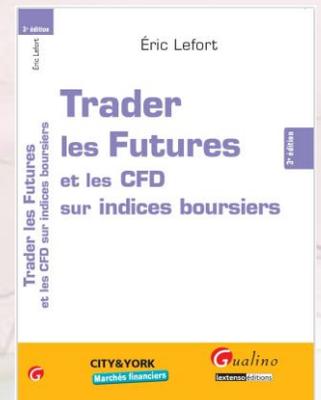
Elaborer un système de trading

Exemple sur le CFD Dow Jones

Présenté par Eric Lefort de Mogalef-Trading.com

En collaboration avec **WHSelfinvest**

Mogalef Trading
"There's no certitude, only opportunities." V



Mercredi 2 décembre 2020

Sommaire

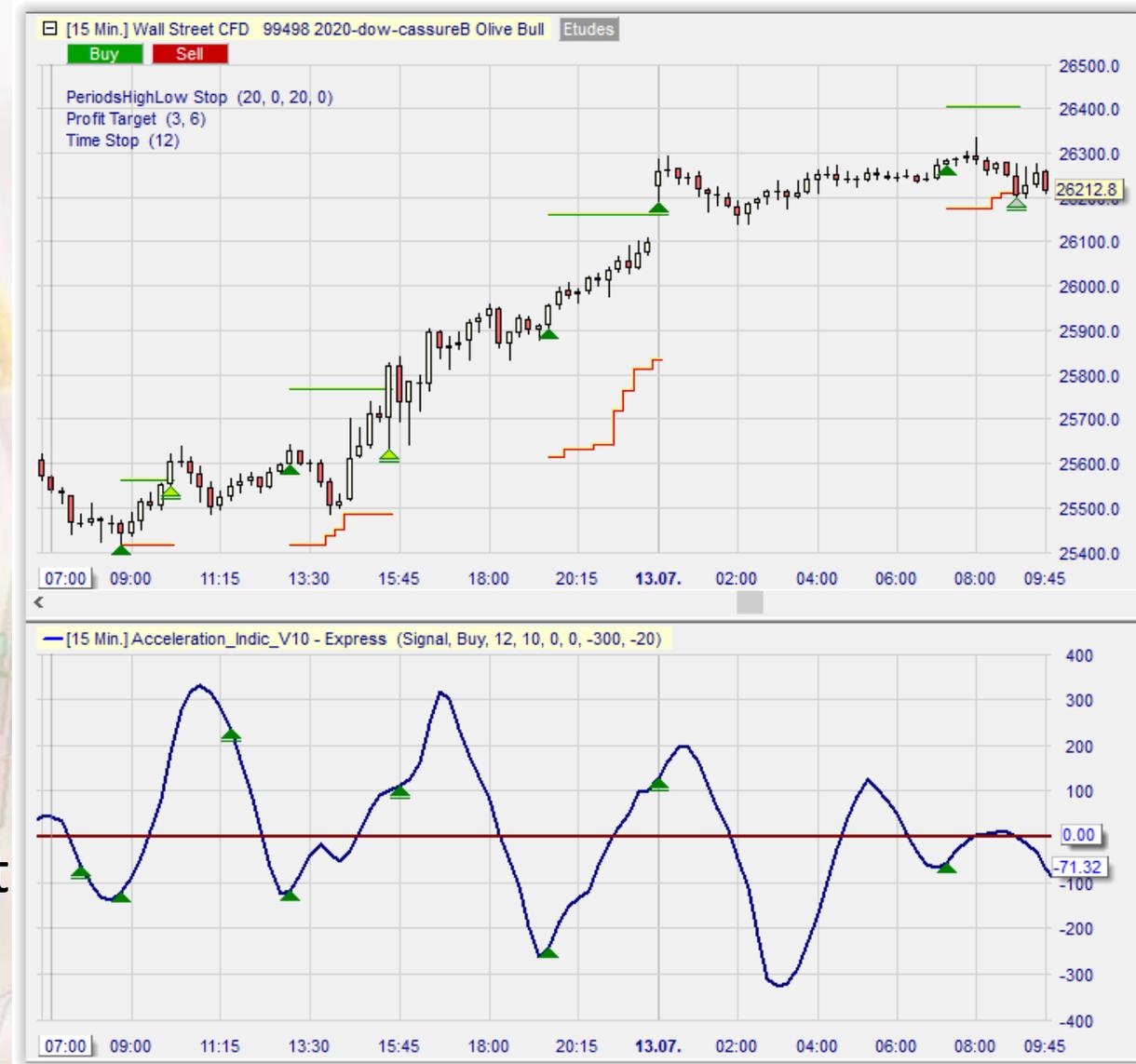
- L'idée de départ
- Transformation de l'idée en indicateur
- Le système à l'achat : insertion d'un objectif et d'un stop-loss suiveur
- Limiter la durée du trade avec un Time Stop
- Filtrer les signaux: le MTF (Mogalef Trend Filter), un filtre monodirectionnel.
- Examen des valeurs de paramètres possibles
- Le système à la vente ; insertion d'un objectif et d'un stop-loss suiveur
- Filtrer les signaux avec le MTF
- Limiter la durée du trade avec un Time Stop
- Examen des valeurs de paramètres possibles
- Combiner l'achat et la vente, rappel sur le MetaSentimentor
- Eliminer les signaux « intermédiaires » avec un indicateur récapitulatif, exemple sur les achats
- Combiner achats et ventes avec les Studies
- Résultat final

L'idée de départ

L'indicateur

- Classique : profiter d'un retournement pour prendre position.
- La détection du retournement se fait avec la régression linéaire
- Pour une meilleure réactivité on se base sur le sens d'accélération et non pas sur la direction des cours.

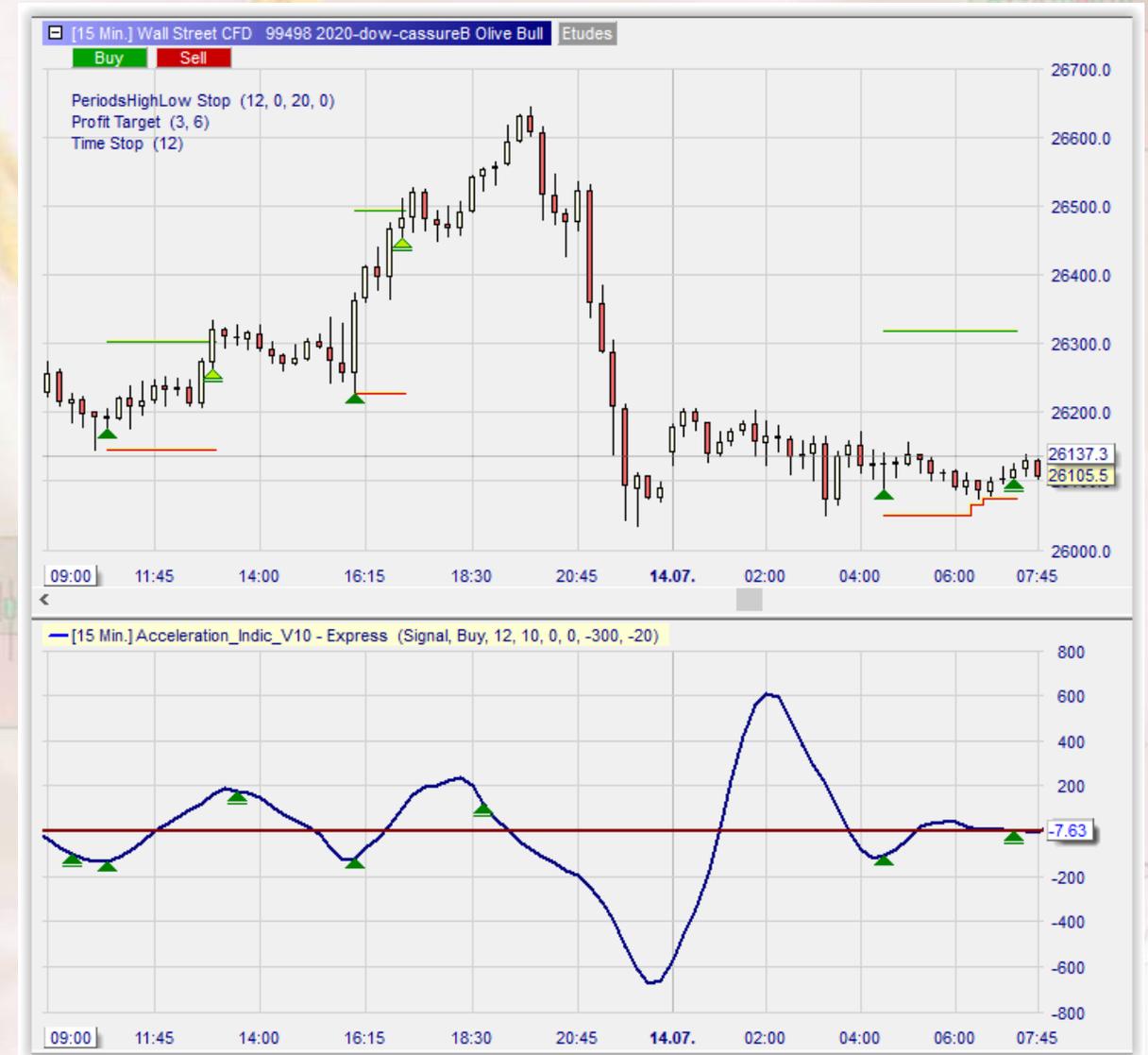
L'indicateur donnant l'accélération est très proche de
« Linear_regression_slope »



Insertion d'un objectif et d'un stop

On se donne un objectif et un stop-loss suiveur

- Objectif 3 ATR
- Stop suiveur PeriodHighLow
- Time stop pour ne pas rester trop longtemps dans le marché



Le résultat avec la courbe des gains

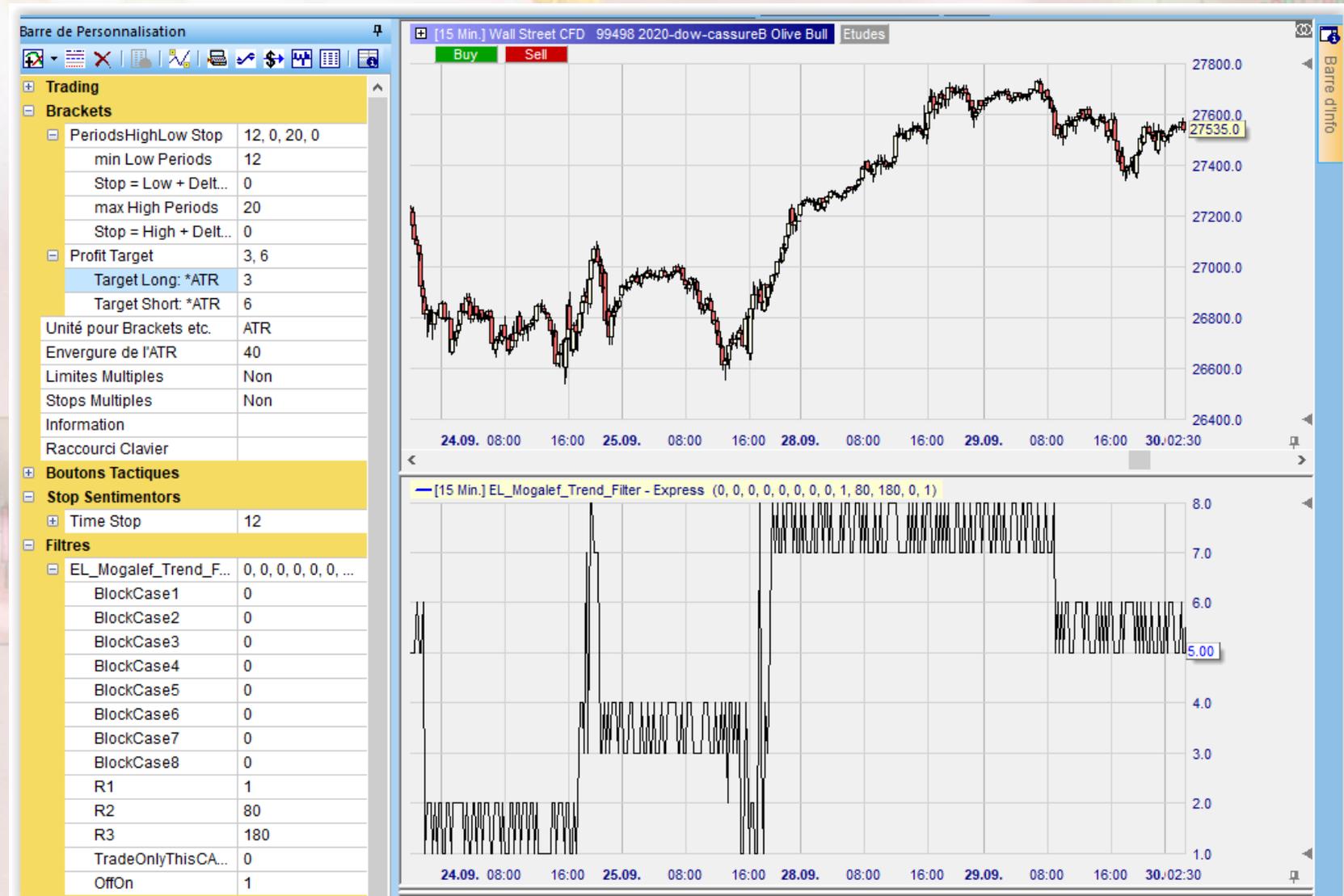
- La courbe de gain est bien orientée mais manque de régularité.
- D'autre part le trade moyen, bien que satisfaisant, reste assez faible.
- Il convient donc d'essayer de filtrer les trades pour ne garder que les meilleurs.



Le Mogalef Trend Filter

Le MTF peut prendre 8 valeurs suivant le sens et la force de la poussée du marché.

- Valeurs 1 et 2 : poussée baissière.
- Valeurs 3 et 4 : range à dominante baissière.
- Valeurs 5 et 6 : range à dominante haussière.
- Valeurs 7 et 8 : Poussée haussière.



Le Mogalef Trend Filter

Il sera possible de filtrer les signaux pour ne trader que les cas où le système est rentable et en éliminant les cas où le système ne rapporte rien.

Le Mogalef Trend Filter fait partie du pack Mogalef :

Il est également disponible séparément du pack.



Ajouter des Sentimentors

Tapez pour rechercher

- Indicateurs
- Indicateurs dans Express
- Manuel
- Sorties & Filtres Horaires
- Stops
- WHS Store
 - Bernard Prats-Desclaux
 - Eric Lefort
 - Mogalef**
 - E_STPMT_Long_Signal
 - E_STPMT_Short_Signal
 - E_XLB_Filter
 - E_XLB_indicator
 - E_XLB_signal
 - EL_ATR_Min_Max [Blocker]
 - EL_AutoAdaptBreakout
 - EL_AutoAdaptBreakoutStop [Stop]
 - EL_AutoAdaptBreakoutTarget [Stop]
 - EL_Bearish_Breakout
 - EL_Block_day [Blocker]
 - EL_Block_hour [Blocker]
 - EL_Bullish_Breakout2
 - EL_CCI_DIV
 - EL_Intelligent_Scalping_Target [Stop]
 - EL_MACD_DIV
 - EL_MOGALEF_Bands
 - EL_MOGALEF_STOP [Stop]
 - EL_Mogalef_Trend_Filter [Blocker]
 - EL_Mogalef_Trend_Indicator
 - EL_Mogalef_Trend_Indicator_v2
 - EL_REPULSE_DIV
 - EL_RSI_DIV
 - EL_STOCH_DIV
 - EL_Stop_Intelligent [Stop]
 - EL_Stop_Intelligent_v2 [Stop]
 - EL_Stop_Intelligent_v2_live [Stop]
 - EL_STPMT_DIV
 - EL_Triangle_Long
 - EL_Triangle_Short
 - EL_Triangle_STOP_Long [Stop]
 - EL_Triangle_STOP_Short [Stop]
 - EL_Wedge_Falling
 - EL_Wedge_Rising
 - signalMACDDivergence

Afficher dans le graphique principal

Afficher dans une sous-fenêtre du graphique principal

Insérer comme: Sentimentor Filtre Stop Tac

Quel sens choisir ?

- Il est évident qu'un filtrage quel qu'il soit, et particulièrement pour le MTF, ne sera pas basé sur les mêmes réglages dans le sens des achats et dans le sens des ventes
- C'est pourquoi dans un premier temps nous examinerons uniquement les achats. Le système sera donc basé sur les entrées uniquement sur les entrées long.

On peut tester les trades correspondant à un état du MTF et voir s'il est rentable de trader dans ce cas.

Ici, pour le cas 1, le gain moyen par trade et l'allure de la courbe de gain ne sont pas favorables.

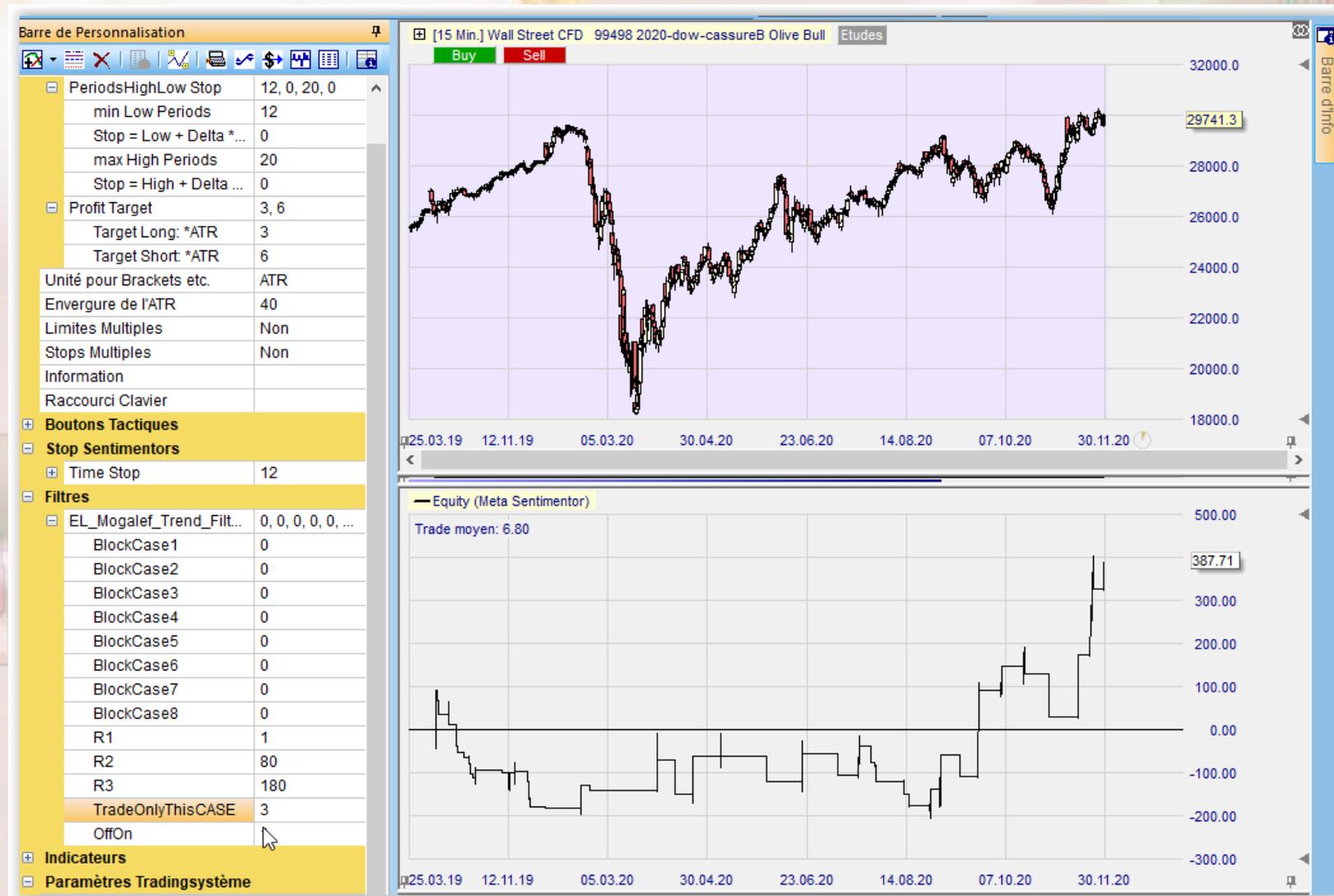


Il n'est pas du tout rentable de trader dans le cas 2 du MTF

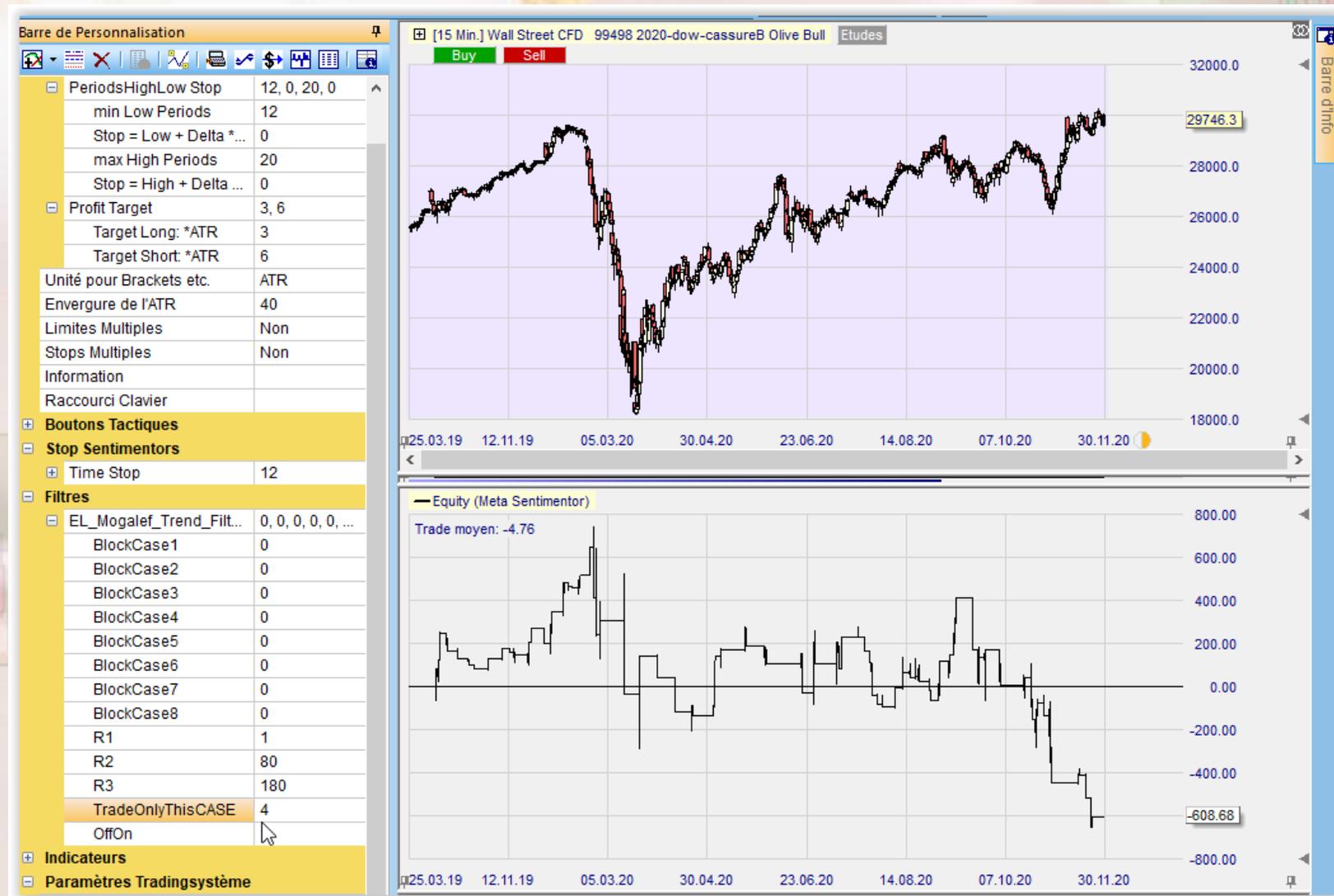


Dans le cas 3 le nombre de trades est limité et peu rentable sauf sur la dernière période.

Nous pouvons garder les trades dans le cas 3.

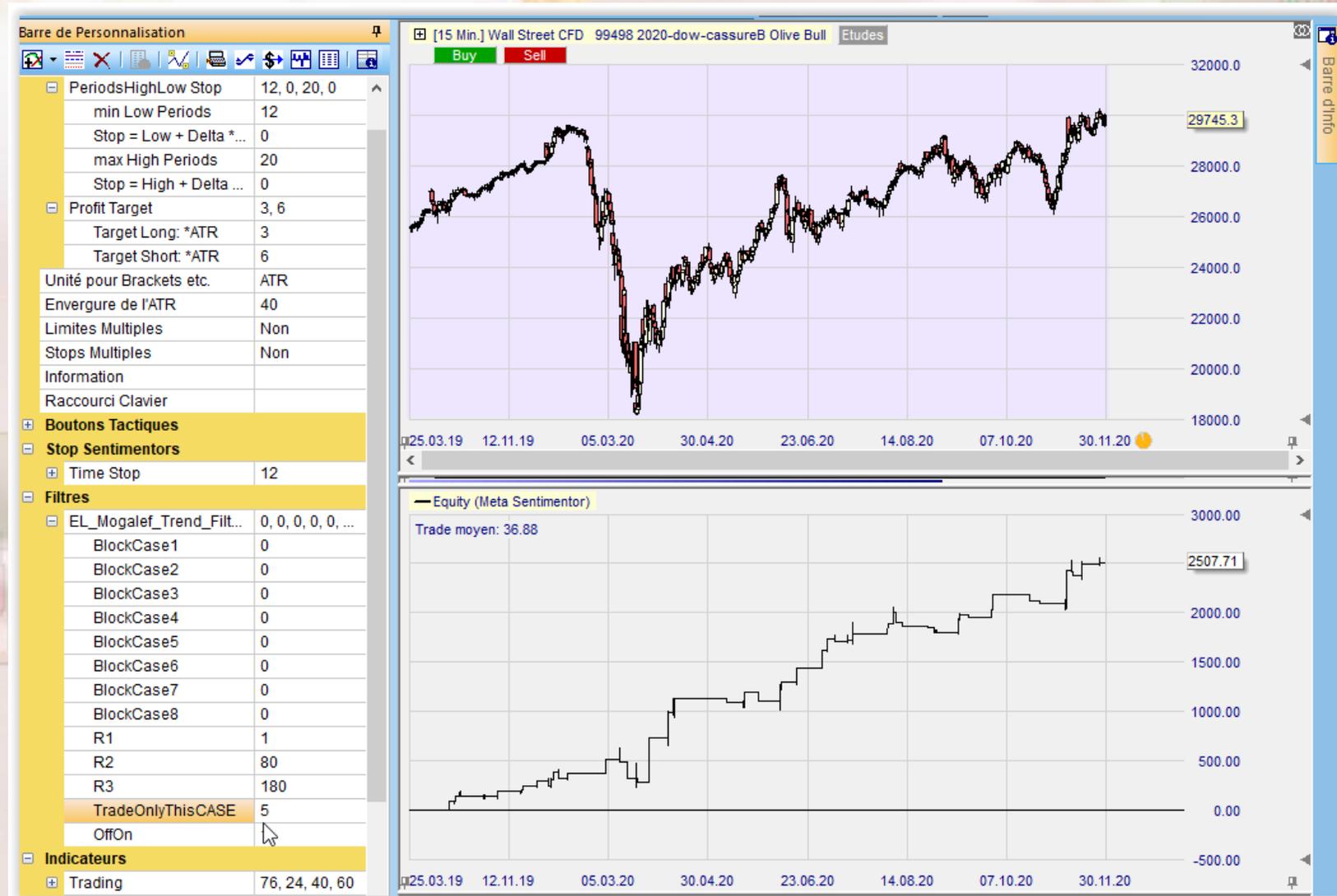


Il n'est pas du tout rentable de trader dans le cas 4 du MTF.



Quand on sélectionne les trades pour une valeur du MTF de 5 la courbe de gain est très bonne et le trade moyen élevé.

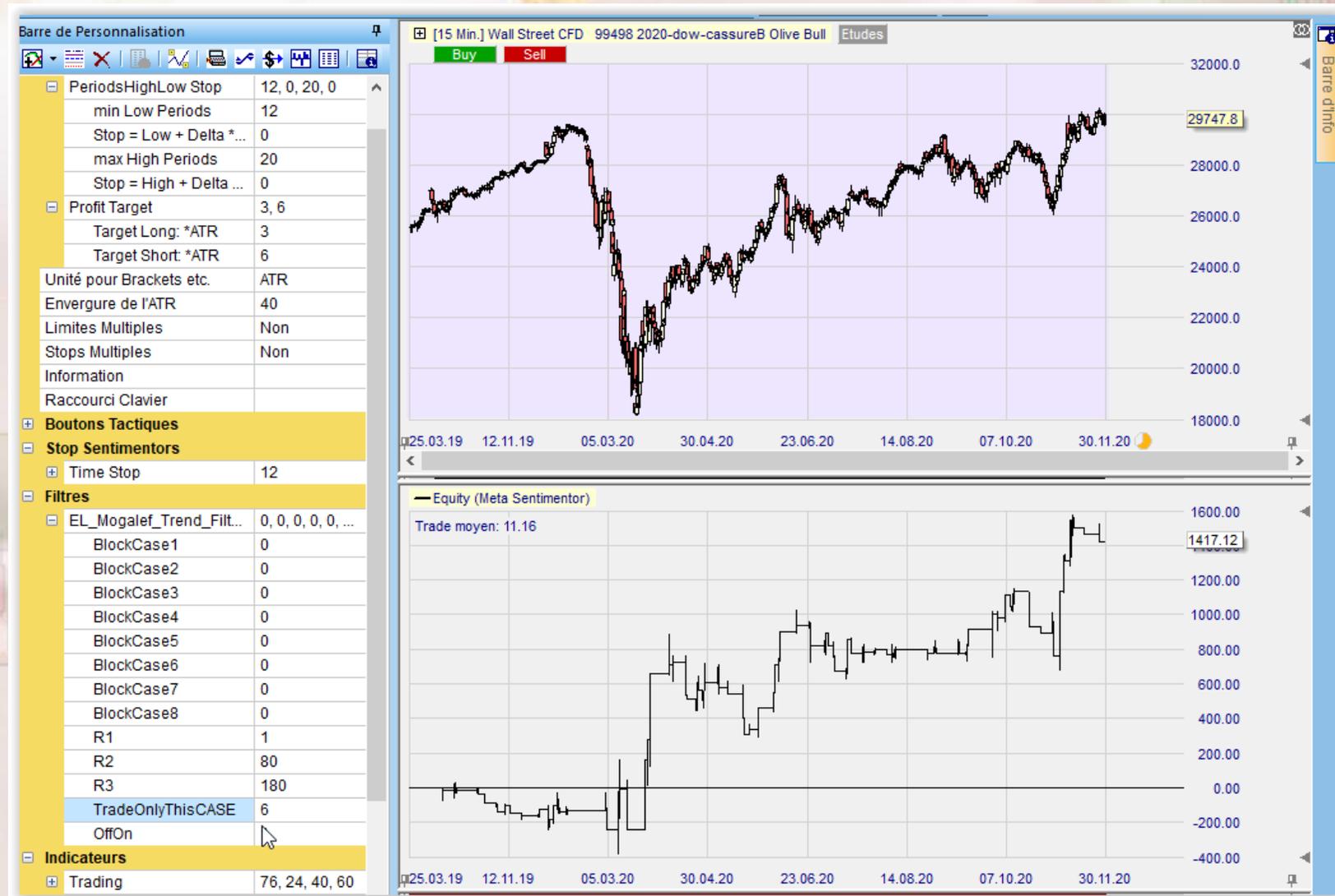
On tradera donc les signaux si le MTF est égal à 5.



Pour un filtre MTF égal à 6 la courbe semble bonne bien que le trade moyen reste faible.

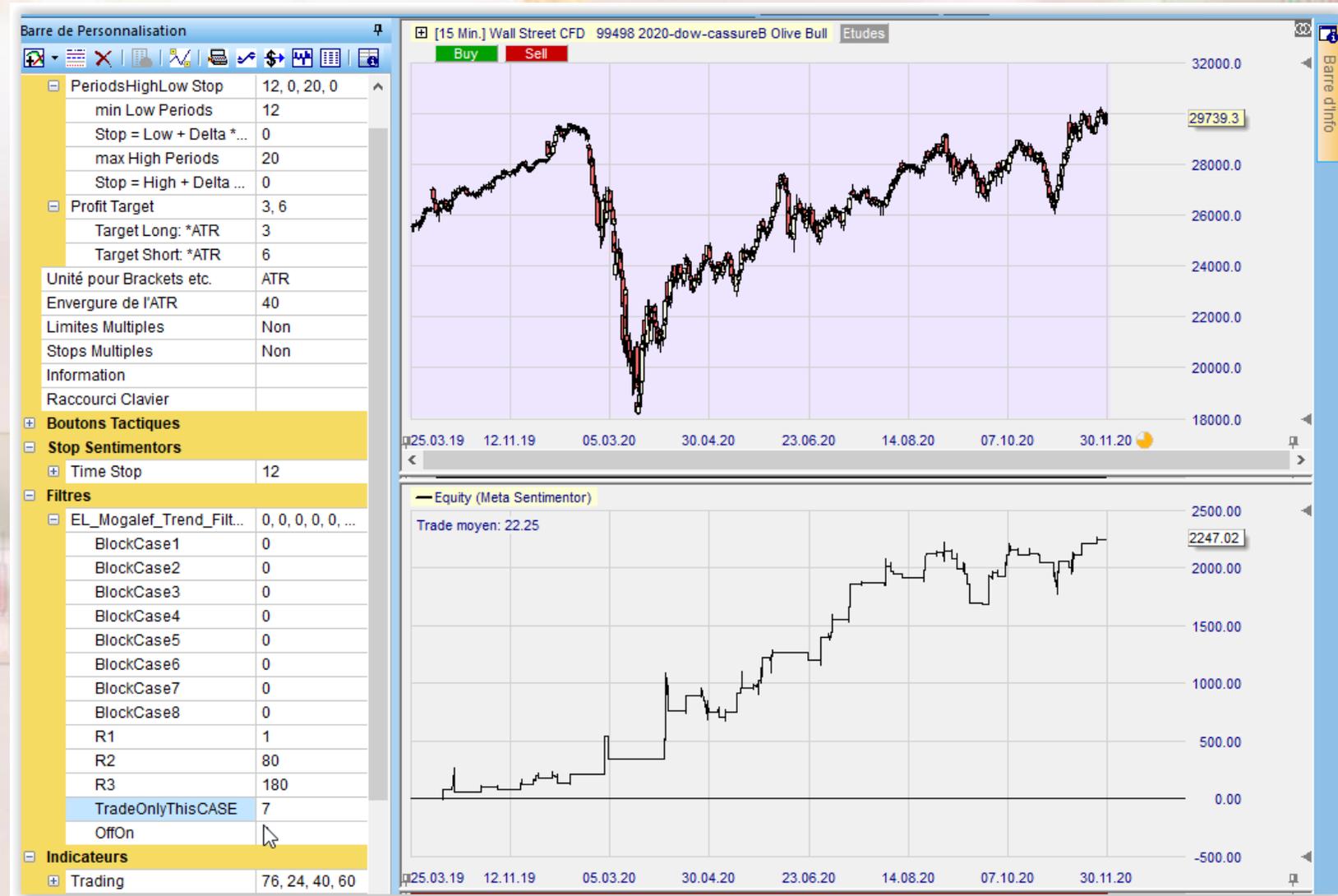
En réalité la hausse ne repose que sur 8 trades parmi 127 ce qui rend ce filtrage douteux.

A réexaminer plus tard, on ne sélectionne pas cette valeur du MTF dans un premier temps.



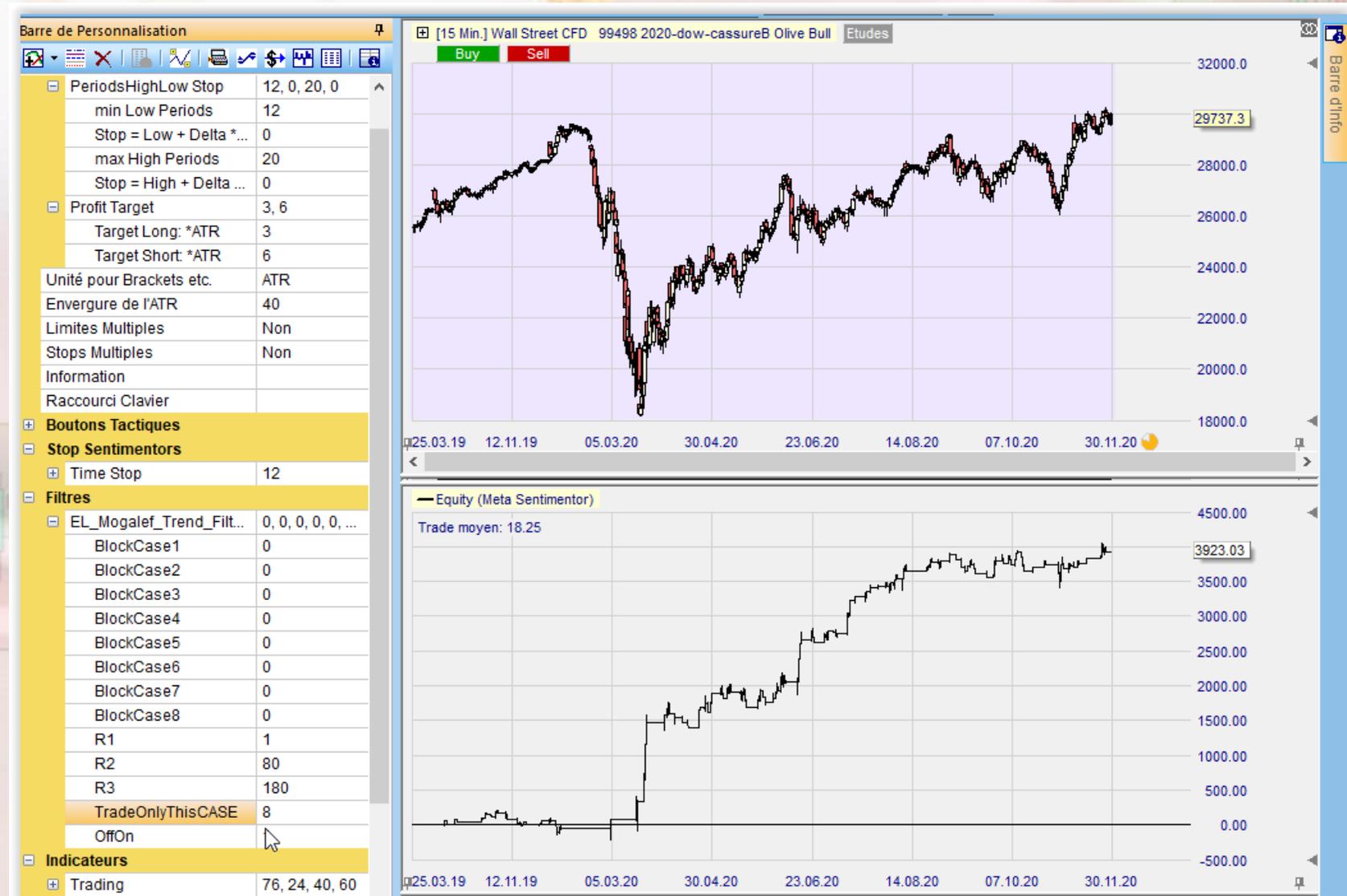
Quand on sélectionne les trades pour une valeur du MTF de 7 la courbe de gain est très bonne et le trade moyen élevé.

On tradera donc les signaux si le MTF est égal à 7.



Pour un MTF égal à 8 on voit un trade moyen intéressant et une courbe de gains sans grande faiblesse.

On tradera donc les signaux si le MTF est égal à 8.

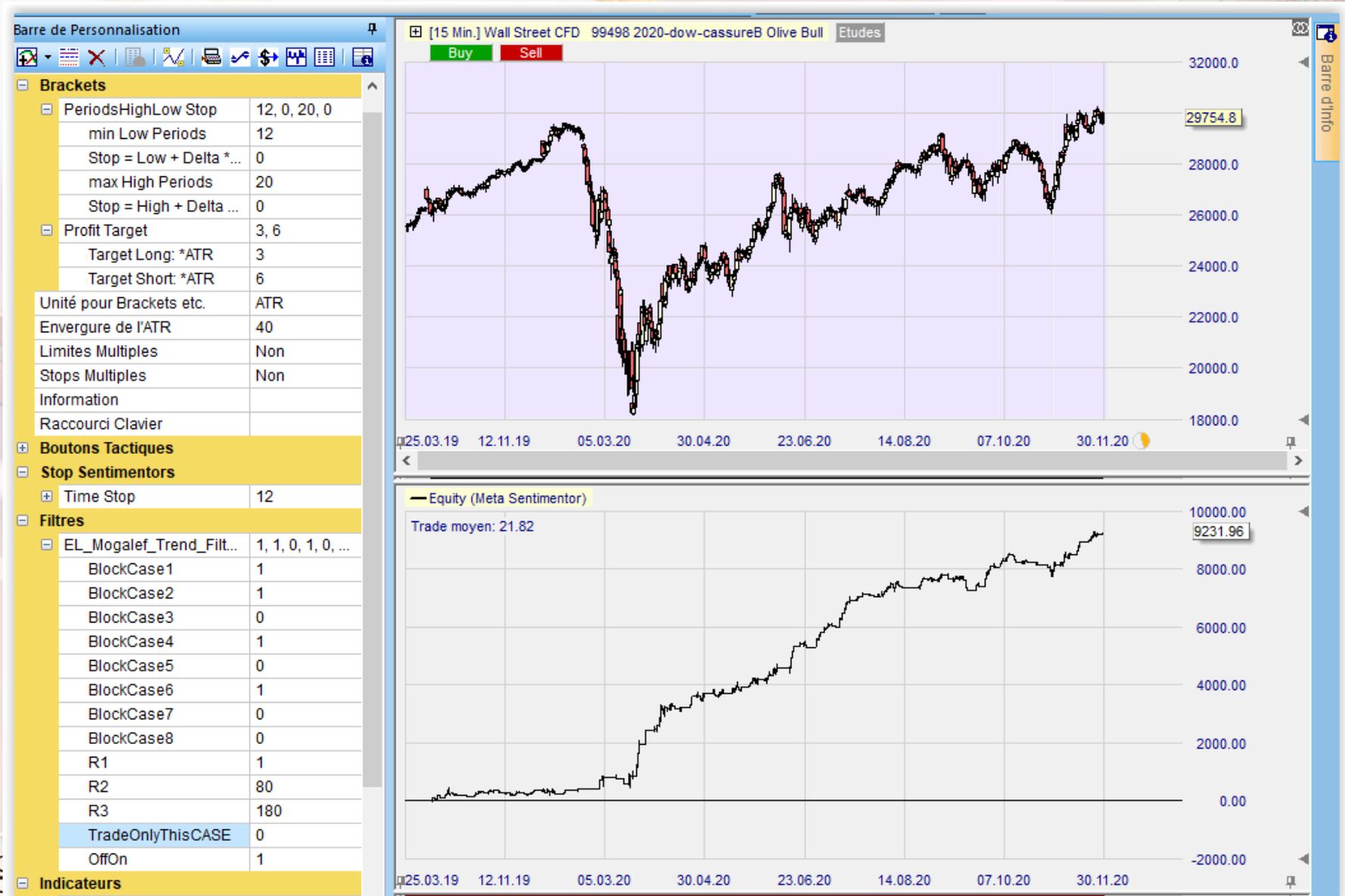


On règle le MTF en fonction de nos observations sur les 8 valeurs possibles de ce filtre:

- On bloque les cas 1,2,4 et 6.
(BlockCase = 1 signifie oui, on bloque ce cas)
- On trade les cas non bloqués, c'est-à-dire les cas 3,5,7 et 8.
(blokCase =0 signifie que ce cas n'est pas bloqué, donc qu'on trade les signaux pour cette valeur du MTFilter)

Filtres	
EL_Mogalef_Trend_Filt...	1, 1, 0, 1, 0, ...
BlockCase1	1
BlockCase2	1
BlockCase3	0
BlockCase4	1
BlockCase5	0
BlockCase6	1
BlockCase7	0
BlockCase8	0
R1	1
R2	80
R3	180
TradeOnlyThisCASE	0
OffOn	1

- Ce qui donne une courbe de gain et un trade moyen beaucoup plus acceptables.



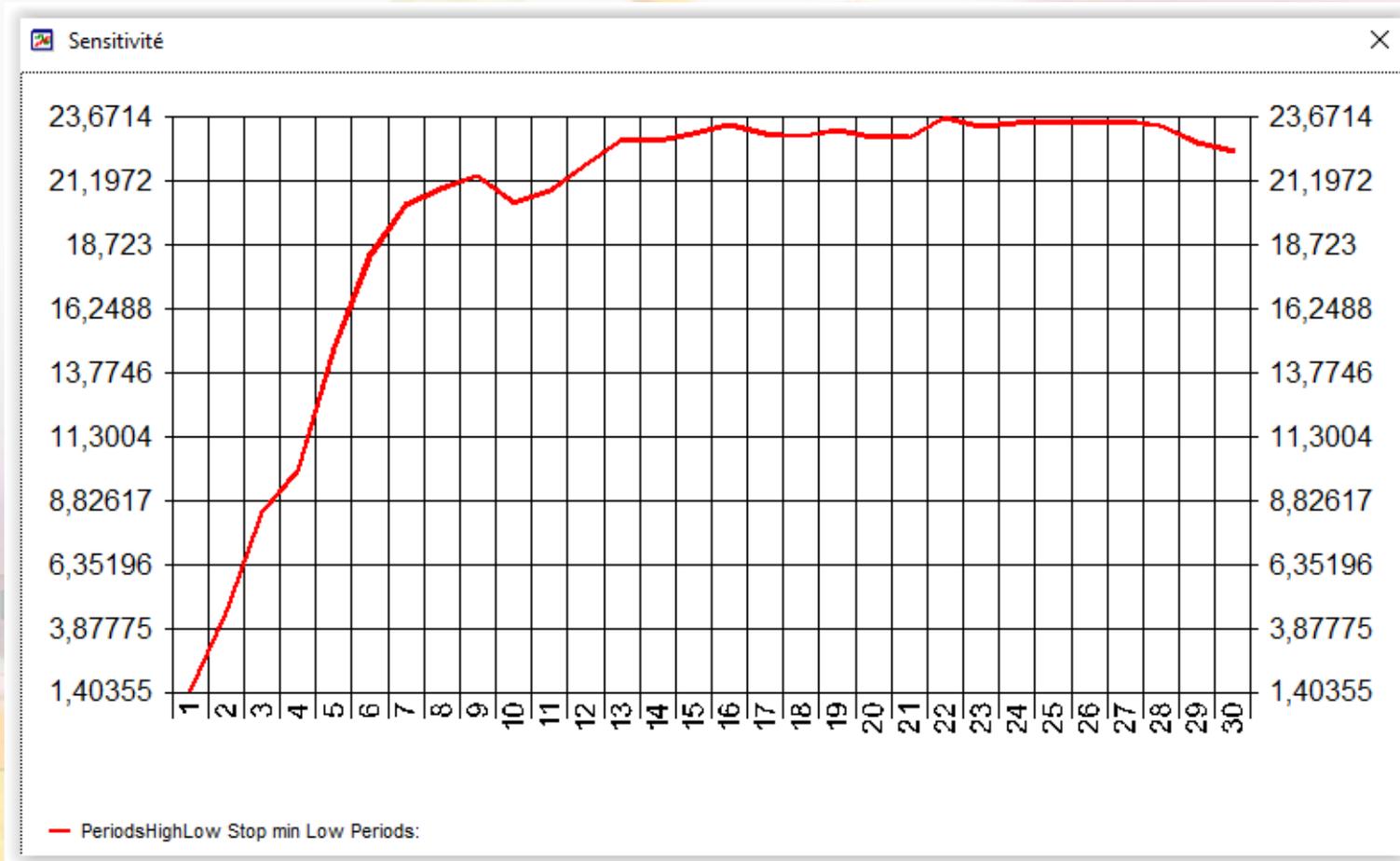
Mais le travail n'est pas fini !

Pour chaque paramètre il convient d'examiner sa stabilité et ses valeurs optimum.

- On demande la valeur du trade moyen pour le paramètre du PeriodHighLow Stop.

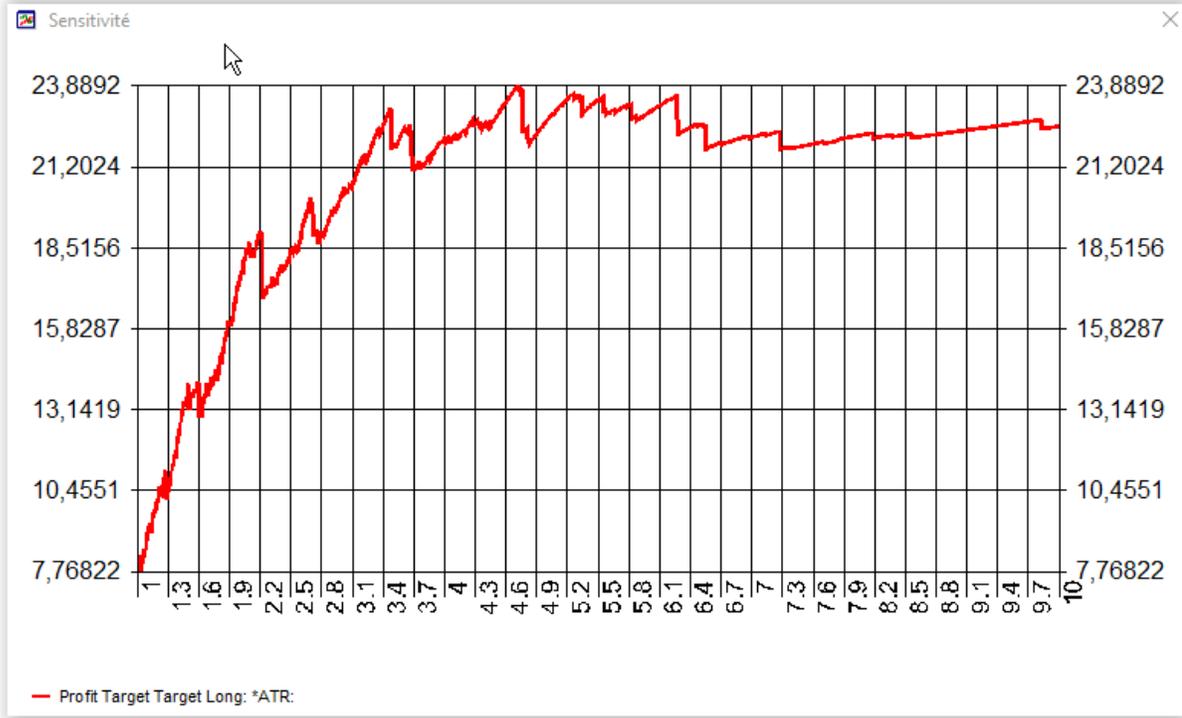
Pour accélérer cet exposé nous ne verrons que quelques paramètres.

The screenshot shows a software interface with a 'Brackets' settings panel on the left and a context menu on the right. The 'Brackets' panel is expanded to show the 'PeriodsHighLow Stop' section, which includes fields for 'min Low Periods' (set to 12), 'Stop = Low + Delta', and 'max High Periods'. Below this are sections for 'Profit Target', 'Unité pour Brackets etc.', 'Envergure de l'ATR', 'Limites Multiples', 'Stops Multiples', 'Information', and 'Raccourci Clavier'. The 'Boutons Tactiques' section is expanded to show 'Stop Sentimentors' (with a sub-item 'Time Stop') and 'Filtres' (with sub-items 'EL_Mogalef_Trend_F', 'BlockCase1', and 'BlockCase2'). The context menu on the right is open, showing options such as 'Visualisation ...', 'Aggregation ...', 'Modifier Interprétation ...', 'Supprimer Sentimentor Actif', 'Remise à zéro Sentimentor Actif', 'Sensibilité du Sentimentor ...', 'Sensibilité du Paramètre ...' (highlighted), 'Recherche Tabou pour Sentimentor actif ...', 'Recherche Exhaustive du Paramètre actif ...', 'Recherche Exhaustive du Sentimentor actif...', 'Fixer le Sentimentor actif', 'Exporter le Sentimentor actif...', 'Mise à Zéro de tous les Sentimentors', 'Fixer Tous les Sentimentors', and 'Supprimer tous les Sentimentors'.



PeriodHighLow Stop

Progression régulière, valeurs optimum entre 15 et 25.



Distance de l'objectif

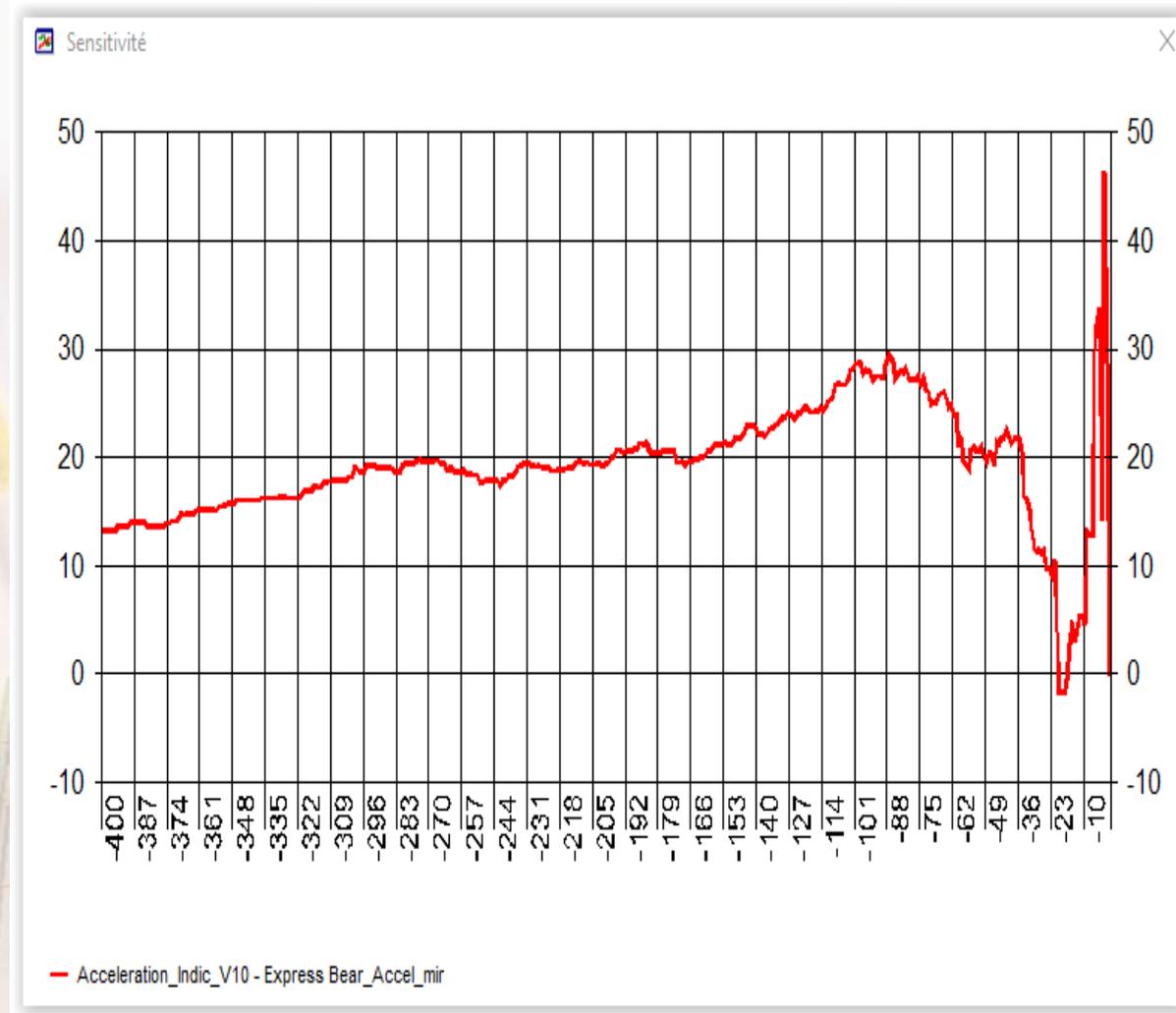
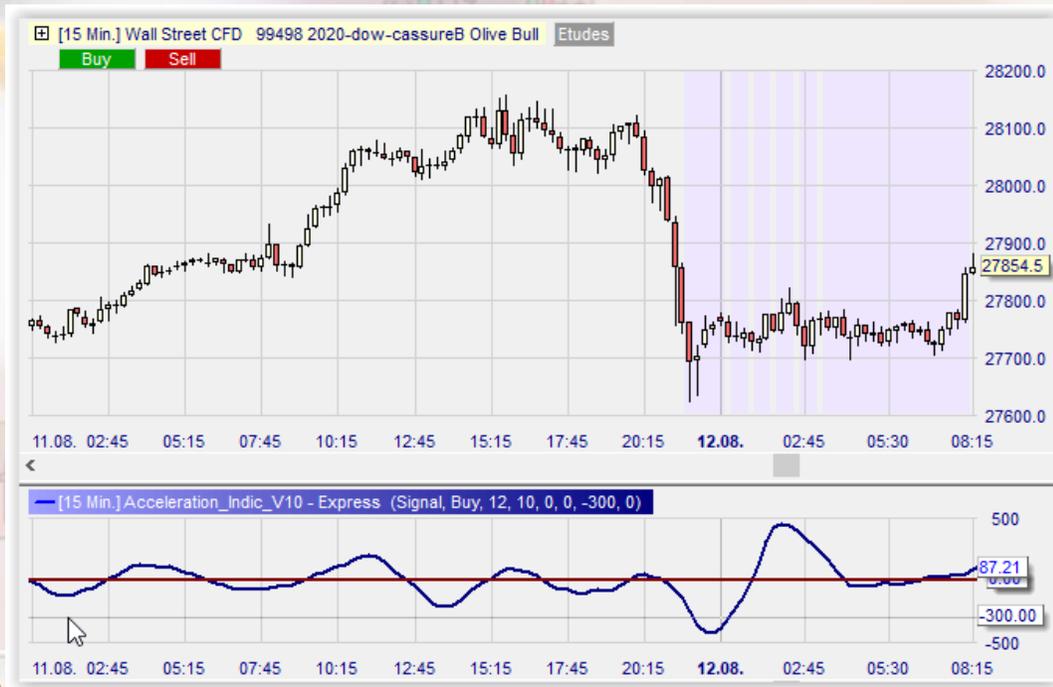
Progression régulière, valeurs optimum à partir de 3.
 Attention : plus la distance augmente, moins on aura de trades

TimeStop

Progression régulière, valeurs optimum à partir de 12.

BearAccelerationMin

- Il s'agit de la puissance de la baisse à partir de laquelle on tente l'achat du retournement. Attention, plus cette valeur est grande moins on aura de trade, donc moins grand sera le bénéfice.



Moins 300 constitue un bon compromis avec un bon gain moyen et un grand nombre de trades.

Au final, voici ce que donne ce système acheteur:



Et, avec les mêmes principes, le système vendeur



Combiner l'achat et la vente

- Nous avons vu que les valeurs du filtre Mogalef Trend Filter n'étaient pas les mêmes sur le système achat et le système vente. Ceci a donc nécessité deux systèmes, un pour les achats et un pour les ventes.
- Le but est de combiner les deux systèmes pour obtenir un seul système complet, à la fois en achat et en vente. Il n'est pas possible de simplement les superposer à cause de ces différences de filtrage.
- Il faudra donc créer un système qui prennent toutes les caractéristiques (y compris le filtre MTF) du système achat, et toutes les caractéristiques (y compris MTF) du système vente.

1, 1, 0, 1, 0, 1, 0, 0, 1, 80, 180, 0, 1

1, 0, 1, 0, 1, 1, 1, 0, 1, 80, 180, 0, 1

Combiner l'achat et la vente

Rappel sur le MetaSentimentor

- Le MetaSentimentor est le « cerveau » de la NanoTrader. C'est lui qui compile tous les **signaux d'indicateurs** pour les traduire en signaux d'achat ou de vente.
- **Ensuite seulement** les filtres (comme le MTF) viennent éliminer les trades non désirables.



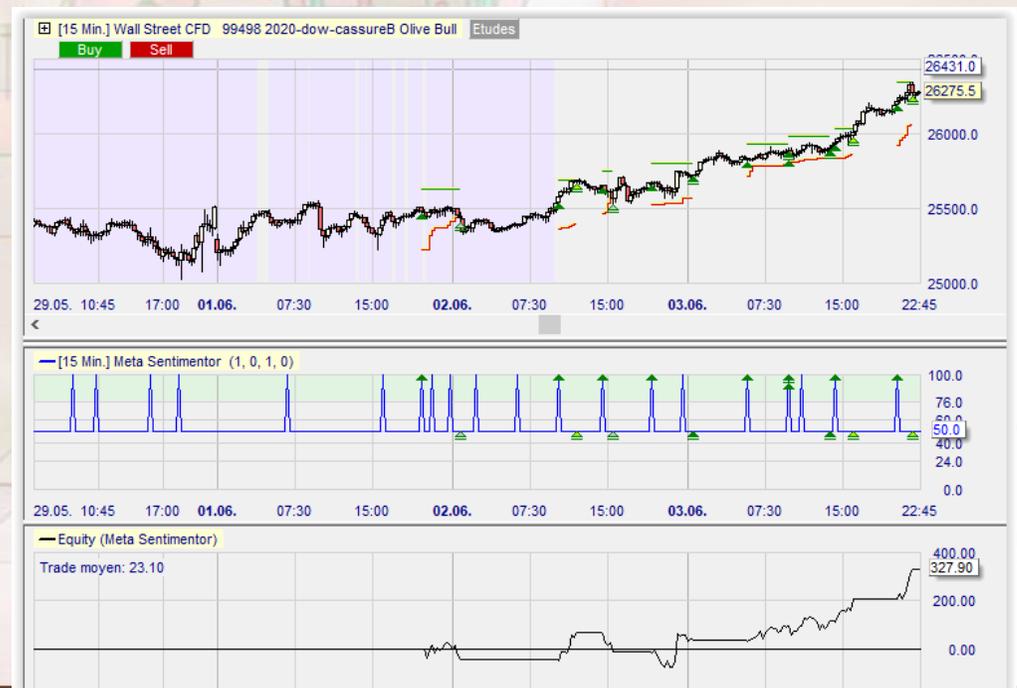
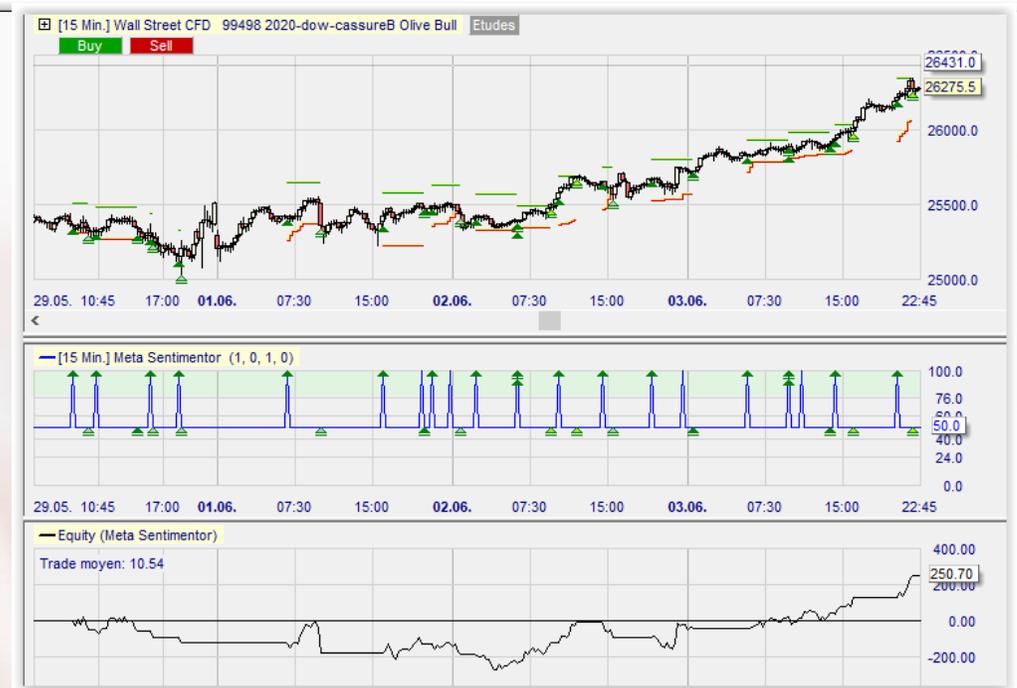
Combiner l'achat et la vente

Rappel sur le MetaSentimentor

- Le MetaSentimentor est le « cerveau » de la NanoTrader. C'est lui qui compile tous les **signaux d'indicateurs** pour les traduire en signaux d'achat ou de vente.

- **Ensuite seulement** les filtres (comme le MTF) viennent éliminer les trades non désirables.

Mais ils ne modifient pas les valeurs du MetaSentimentor



Combiner l'achat et la vente

- Or seules les valeurs du MetaSentimentor peuvent être transmises d'un système (achat ou vente) à l'autre (système complet). Les filtres ne sont donc pas transmis.
- La seule solution consiste à transformer les filtres en indicateurs.

C'est pourquoi j'ai écrit le Mogalef Trend Indicator.

Celui-ci est fourni dans le pack « Mogalef Trend Filter » et dans le Pack complet « Mogalef » :



Ajouter des Sentimentors

Tapez pour rechercher

- Indicateurs
- Indicateurs dans Express
- Manuel
- Sorties & Filres Horaires
- Stops
- WHS Store
 - Bernard Prats-Desclaux
 - Eric Lefort
 - Mogalef
 - E_STPMT_Long_Signal
 - E_STPMT_Short_Signal
 - E_XLB_Filter
 - E_XLB_Indicator
 - E_XLB_Signal
 - EL_ATR_Min_Max [Blocker]
 - EL_AutoAdaptBreakout
 - EL_AutoAdaptBreakoutStop [Stop]
 - EL_AutoAdaptBreakoutTarget [Stop]
 - EL_Bearish_Breakout
 - EL_Block_day [Blocker]
 - EL_Block_hour [Blocker]
 - EL_Bullish_Breakout2
 - EL_CCI_DIV
 - EL_Intelligent_Scalping_Target [Stop]
 - EL_MACD_DIV
 - EL_MOGALEF_Bands
 - EL_MOGALEF_STOP [Stop]
 - EL_Mogalef_Trend_Filter [Blocker]
 - EL_Mogalef_Trend_Indicator
 - EL_Mogalef_Trend_Indicator_v2**
 - EL_REPULSE_DIV
 - EL_RSI_DIV
 - EL_STOCH_DIV
 - EL_Stop_Intelligent [Stop]
 - EL_Stop_Intelligent_v2 [Stop]
 - EL_Stop_Intelligent_v2_live [Stop]
 - EL_STPMT_DIV
 - EL_Triangle_Long
 - EL_Triangle_Short
 - EL_Triangle_STOP_Long [Stop]
 - EL_Triangle_STOP_Short [Stop]
 - EL_Wedge_Falling
 - EL_Wedge_Rising
 - signalMACCDivergence

WHS

Afficher dans le graphique principal

Afficher dans une sous-fenêtre du graphique principal

Insérer comme:

Signaux d'achat
d'indicateur

↓
Metasentimentor

↓
Filtre (MTF)

↓
Système
Acheteur

Signaux de vente
d'indicateur

↓
Metasentimentor

↓
Filtre (MTF)

↓
Système
Vendeur

Système global
achats et ventes

On ne veut pas ça.

Signaux d'achat
d'indicateur

↓
+ Filtre transformé
en **indicateur**

↓
Metasentimentor

↓
Système
Acheteur

Signaux de vente
d'indicateur

↓
+ Filtre transformé
en **indicateur**

↓
Metasentimentor

↓
Système
Vendeur

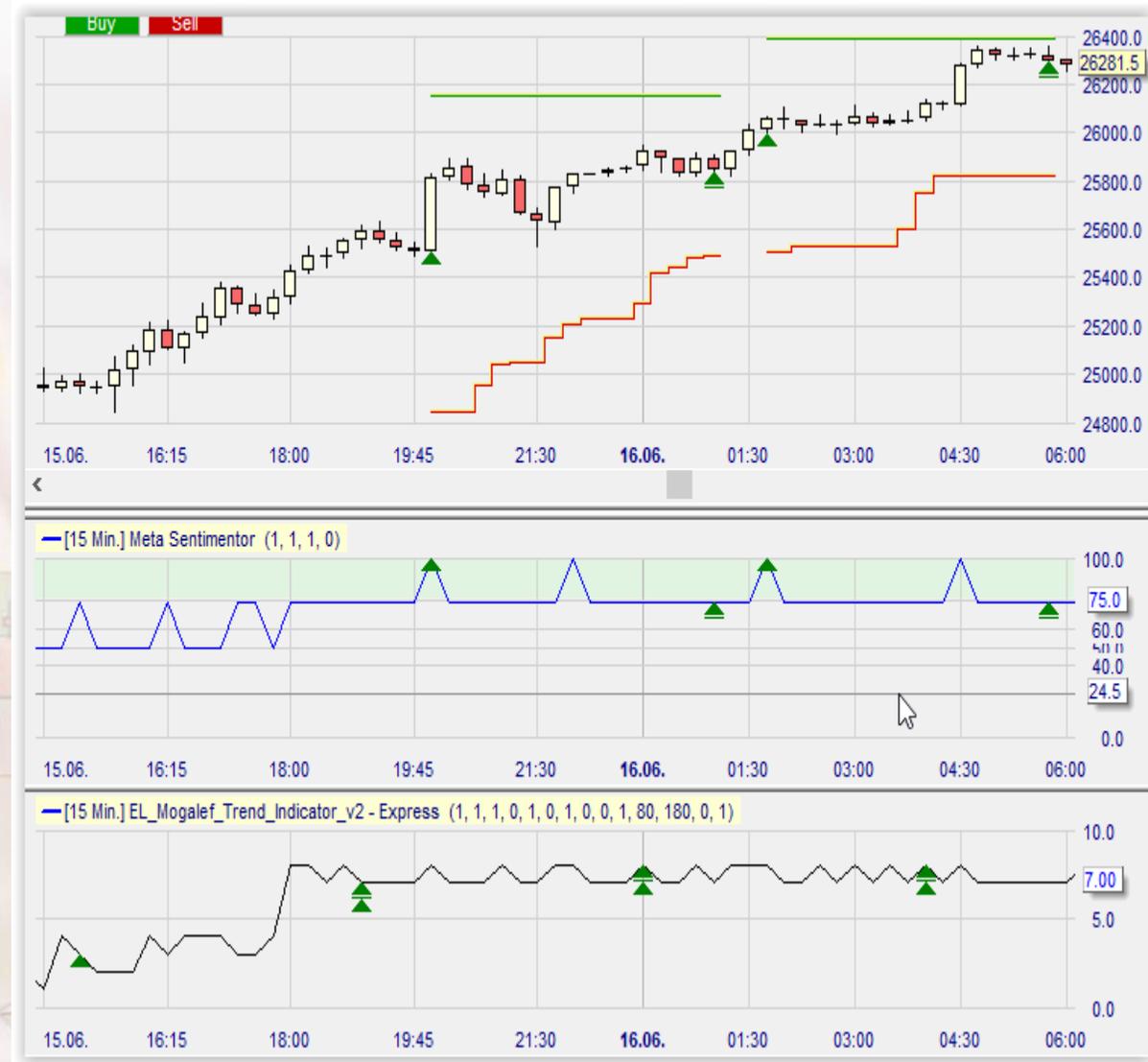
Système global
achats et ventes

On veut ça.

Combiner l'achat et la vente

- On remplace le filtre MTF par l'indicateur Mogalef Trend Indicator V2.
- On obtient ainsi le même résultat que si le filtre était employé.
- Cependant on voit que le MetaSentimentor peut prendre les valeurs :
 - 50 si pas de signal et pas de MTI.
 - 75 si signal OU MTI.
 - 100 Si signal ET MTI.

Il faut supprimer cette valeur de 75 qui fausserait notre système achat+vente.



Combiner l'achat et la vente

On veut uniquement les valeurs

- 50 (pas de signal)
- ou 100 (signal et filtre OK)

Pour ce faire il suffit de créer un petit indicateur qui interprète l'indicateur signal et l'indicateur MTI, puis de ne tenir compte que de cet indicateur.

Le détail et le code de ce petit indicateur, ainsi que tout le nécessaire pour reproduire ce système sont disponibles sur le **forum Mogalef** ici :



<https://www.mogalef-trading.com/forum/aide-indicateurs-mogalef/en-cours-de-programmation-indicateur-d-acceleration/p-3>

Pour avoir accès à tous les fichiers nécessaires pour reproduire le système complet il vous suffit de vous inscrire sur le forum Mogalef.

L'inscription ne donne lieu à aucune vente de vos données (votre adresse mail) et ne provoque aucune sollicitation (Pas de pub).

Vous verrez également comment ce système a été travaillé et mis au point par les membres.

Sign Up

Already a member? [Log In](#)

Email

Password

Join this site's community. [Read more](#)

Commenter 0

Eric oct. 5

[Acceleration_Indic_V10.txt](#)
Télécharger TXT • 16KB

[Acceleration_Study_Interpretation.txt](#)
Télécharger TXT • 2KB

[2020-Acceleration.txt](#)
Télécharger TXT • 1KB

Commenter 0

Eric oct. 5

Ces trois derniers fichiers sont à télécharger directement par lien :

[Wall Street CFD#99498#2020-dow-cassureB Olive bear.dys](#)
DYS File

[Wall Street CFD#99498#2020-dow-cassureB Olive Bull.dys](#)
DYS File

[Wall Street CFD#99498#2020-dow-Acceleration.dys](#)
DYS File

Commenter 0

Ne plus suivre

659 vues

108 commentaires

Posts similaires

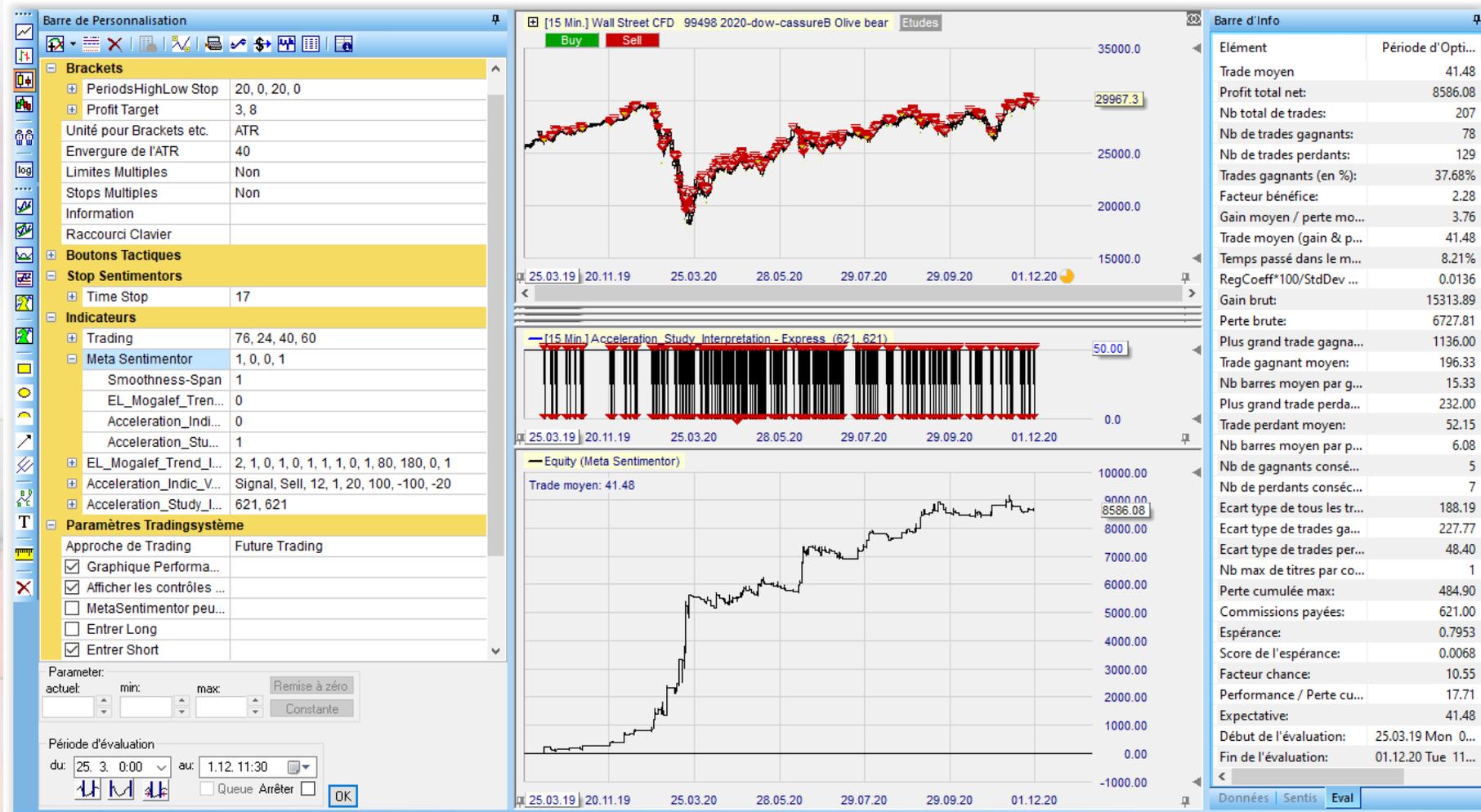
- Les boucles en programmation
- Les bases de la programmation en langage EXPRESS
- Stpmt long + bullish breakout

Catégories

- Discussions générales
- Présentations
- Aide indicateurs Mogalef
- Aide à la programmation
- Trading DAX
- [Voir toutes les catégories](#)

Combiner l'achat et la vente

Le même travail est effectué pour les signaux baissiers.



Combiner l'achat et la vente

Puis on combine les systèmes Achat et Vente en un seul système global qui peut être mis en automatique par la NanoTrader.



Merci de votre attention.

- Site Mogalef-Trading
- Les outils Mogalef sont disponibles sur le Store de la NanoTrader ou bien directement sur le site Mogalef-Trading



Mogalef Trading
"There's no certitude, only opportunities." V

Navigation: HOME SYSTEMS NEWS INDICATORS TOOLS PRIVATES CLUBS PRACTICE WITH MOGALEF FORMATIONS Forums Mogalef Membres

Un système de trading sur Dow élaboré en commun

Sur la base de cet indicateur (linear regression slope), la communauté a construit plusieurs possibilités de systèmes de trading. Plusieurs systèmes semblent très prometteurs. Découvrez le travail de tous et reproduisez ce système chez vous.

N'hésitez pas à apporter ou à questionner, le forum est fait pour ça!
[Plus de détails ICI.](#)

Vidéos sur Youtube

- [Daytrading DAX par Eric Lefort, 2020 le 21 mars](#)
- [Daytrading DAX par Eric Lefort, 2020 le 09 avril](#)
- [Daytrading DAX par Eric Lefort, 2020 le 16 avril](#)
- [Daytrading DAX par Eric Lefort, 2020 le 23 avril](#)

Résumés des journées de trading live du stage "Trading discrétionnaire" sur [Youtube \(toutes les vidéos\)](#).
Les erreurs à ne pas commettre, l'analyse des cycles, comment élaborer son plan et le suivre, ces thèmes sont



Je n'utilise que NanoTrader. C'est la seule plateforme que je connaisse qui détienne toutes les qualités dont a besoin un trader.
Eric Lefort

Pack Mogalef trading

Ce pack contient de nombreux outils exclusifs et des signaux de trading faciles à utiliser développés par le trader Eric Lefort sous sa marque Mogalef.

NanoTrader est la seule plateforme à avoir tous les outils dont un trader a besoin. Découvrez la démo.
Eric Lefort

Le filtre de tendance Mogalef

Ce filtre est très précis et peut être ajouté à n'importe quelle stratégie de trading. Il identifie huit situations de tendance et rejettera tous les signaux de trading qui se produisent en dehors d'une situation de tendance.